



短期市場の推移

| | 10月20日 | 10月23日 | 10月24日 | 10月25日 |
|-------------|---------|---------|---------|---------|
| 加重平均金利 | ▲0.010 | ▲0.012 | ▲0.014 | ▲0.018 |
| 東京レポレート(TN) | ▲0.095 | ▲0.100 | ▲0.099 | ▲0.101 |
| 無コール残 | 150,250 | 152,074 | 151,121 | 150,159 |
| ON | 81,703 | 82,187 | 81,634 | 78,452 |
| その他 | 68,547 | 69,887 | 69,487 | 71,707 |
| 有コール残 | 27,606 | 27,683 | 27,448 | 28,380 |

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表
※加重平均金利は無担保コールONのもの、無有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

本日の短期市場金利

| | 無担保コール(速報) | | | レポ市場 |
|-----|------------|--------|--------|---------|
| | 最低 | 最高 | 平均 | 東京レポレート |
| O/N | ▲0.087 | ▲0.005 | ▲0.019 | ▲0.099 |
| T/N | - | - | - | ▲0.119 |
| S/N | - | - | - | - |
| 1W | ▲0.040 | 0.000 | ▲0.028 | ▲0.146 |
| 2W | ▲0.020 | 0.030 | ▲0.001 | ▲0.157 |
| 3W | - | - | - | ▲0.161 |
| 1M | - | - | - | ▲0.168 |
| 2M | - | - | - | - |
| 3M | - | - | - | ▲0.191 |
| 6M | - | - | - | ▲0.113 |
| 1Y | - | - | - | ▲0.081 |

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

10月27日の予定 (時刻は日本時間)

| | 日本 | 予想 | 海外 | 予想 |
|------|--------------|----|----|----|
| 8:50 | 貿易収支 (10月上旬) | | | |
| | - | | - | |
| | - | | - | |

本日の市況

無担保コールON物は▲0.018%の出合から始まり、その後は主に▲0.028%~▲0.010%の水準で取引された。オファー・ビッドの動向に大きな変化は見られず、ON物加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.019%となった。

| 都銀・信託 | 証券 | 地銀 |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| ▲0.040 ~ ▲0.040 | ▲0.018 ~ ▲0.018 | ▲0.028 ~ ▲0.010 |

翌営業日のマーケット

週末3日積みでビッドサイドの調達意欲の強まりが想定され、出合の水準は横ばい圏から若干の上昇を予想。

資金需給

| | 日銀速報 | | 日銀予想 | | 当社需給予想 | |
|---------|-----------|-----------|---------|--------|--------|-----------|
| | 10月26日 | 10月27日 | 10月27日 | 10月30日 | 10月30日 | 10月30日 |
| 債券 | ▲1,300 | ▲400 | | | | +0 |
| 財政 | ▲200 | +1,100 | | | | +1,000 |
| 過不足 | ▲1,500 | +700 | | | | +1,000 |
| 金融調節 | エンド | スタート | エンド | スタート | エンド | スタート |
| CP等買入 | ▲300 | | ▲300 | | | |
| 社債等買入 | ▲100 | | | | | |
| 国債補完供給 | +36,300 | ▲38,200 | +38,200 | | | |
| 当座預金増減 | ▲3,800 | +38,600 | | | | +1,000 |
| 当座預金残高 | 5,512,600 | 5,551,200 | | | | 5,552,200 |
| 準備預金残高 | 4,818,600 | | | | | |
| 積み終了先 | 4,816,100 | | | | | |
| 超過準備 | 4,816,100 | | | | | |
| 非準備先残高 | 694,000 | | | | | |
| 準備預金進捗率 | 99.6% | | | | | |
| 平均 | 35.5% | | | | | |
| 乖離率 | 64.1% | | | | | |

10月26日のオペ結果

オベ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 按分

国債買入(固定利回り方式)(10/27~)

5~10年 0 0

5~10年 0 0

CP等買入(10/31~)

4,000 7,355 4,000 0.000 0.023 83.5

国債補完供給(10/26~10/27)

38,994 38,994 ▲0.350 ▲0.351

20 20 ▲0.350 ▲0.350

マネタリーベース (億円)

10月25日時点 6,770,800

所要

今積期の所要準備額 4,006,500

10月27日以降の残り所要

積数 15,100

平均 800

国債短期証券入札予定

| | |
|--------|-------------|
| 10月27日 | 3ヶ月(第1191回) |
| 11月2日 | 3ヶ月(第1192回) |
| 11月9日 | 6ヶ月 |
| 11月10日 | 3ヶ月 |

国債入札予定

| | |
|--------|------|
| 10月30日 | 2年 |
| 11月2日 | 10年 |
| 11月7日 | 物価連動 |
| 11月9日 | 30年 |

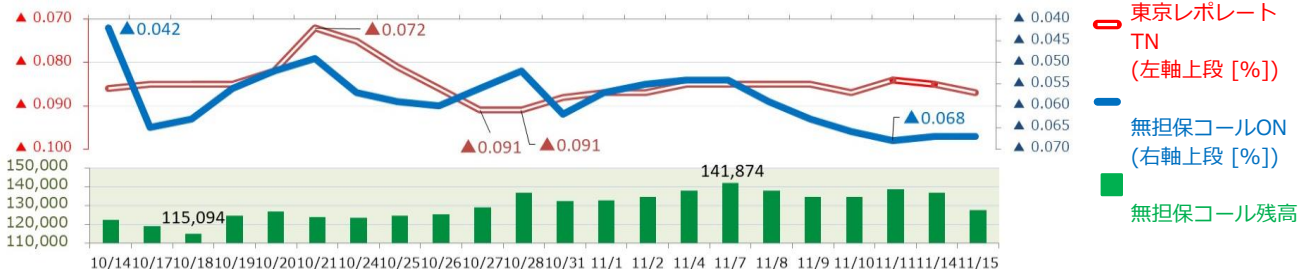
今月の国債買入オペ予定

| オペ種類 | 一回当たりオファー金額 | 直近オファー額 | オファー予定日 | 直近日 | 残り回数 |
|-----------|-------------|---------|-------------|--------|------|
| 1年以下 | 1500 | 1,500 | 月1回 | 10月4日 | 0 |
| 1年超3年以下 | 3,500~6,500 | 4,250 | 4 10 16 23 | 10月23日 | 0 |
| 3年超5年以下 | 4,000~7,500 | 4,500 | 4 16 23 27 | 10月23日 | 1 |
| 5年超10年以下 | 4,500~9,000 | 3,000 | 10 16 23 27 | 10月24日 | 1 |
| 10年超25年以下 | 1,000~5,000 | 1,000 | 4 10 23 27 | 10月24日 | 1 |
| 25年超 | 500~3,500 | 1,000 | 10 16 27 | 10月16日 | 1 |
| 物価連動債 | 600 | 600 | 月1回 | 9月27日 | 1 |
| 変動利付債 | - | 300 | - | 4月14日 | - |

1年前の市場推移

○2022年10月積み期 [10月14日~11月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会